中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：2016年07月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）	
场内简称	中欧300	
基金主代码	166007	
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2010年06月24日	
报告期末基金份额总额	63,914,360.25份	
投资目标	本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数，在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
下属分级基金的场内简称	中欧300	–
下属分级基金的交易代码	166007	001884
报告期末下属分级基金的份额总额	63,538,596.21份	375,764.04份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年04月01日-2016年06月30日）	
	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
1.本期已实现收益	-117,060.50	-767.19
2.本期利润	-501,050.89	-2,147.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0077	-0.0060
4.期末基金资产净值	69,904,158.77	413,631.27
5.期末基金份额净值	1.1002	1.1008

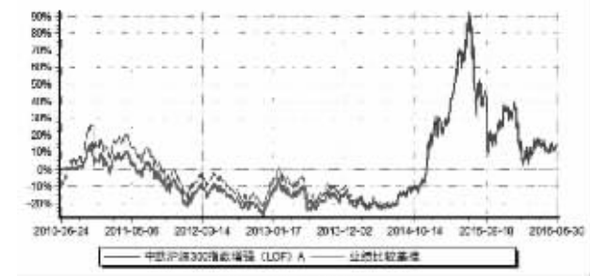
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中欧沪深300指数增强（LOF）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.70%	1.00%	-1.88%	0.96%	1.18%	0.04%

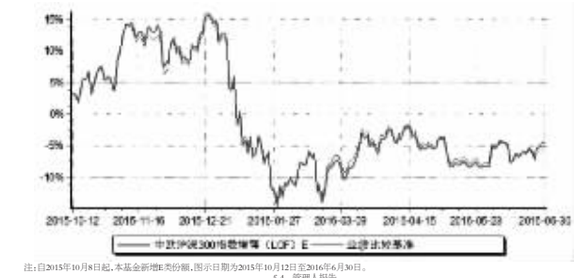
中欧沪深300指数增强（LOF）E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.60%	1.00%	-1.88%	0.96%	1.28%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
中欧沪深300指数增强型证券投资基金A（LOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2010年06月24日-2016年6月30日）



中欧沪深300指数增强型证券投资基金E（LOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年10月12日-2016年6月30日）



注：自2015年10月8日起，本基金新增E类份额，图示日期为2015年10月12日至2016年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	事业部负责人、基金经理	2015年05月18日		9年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司资本投资业务线高级副总裁，2015年4月加入中欧基金管理有限公司，现任事业部负责人，中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》及其各项实施细则，本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
二季度以来，由于债券市场违约事件频发，涉及规模210亿以上，加上铁物资债券停止交易、央企地方国企的信仰打破、城投债提前偿还闹剧，造成二季度债市信用风险升温。而在基金赎回压力下，信用风险向流动性风险蔓延，导致4月债券调整。
报告期内，本基金保持组合流动性的基础上，继续配置收益相对较高的并具有较高流动性的债券，并在流动性冲击时点增加对存单的投资。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内，基金份额净值收益率为0.7%，同期业绩比较基准收益率为-1.88%；E类份额净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准收益率为-1.88%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	66,113,674.17	93.62
	其中：股票	66,113,674.17	93.62
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	3,980,563.42	5.64
8	其他资产	524,792.86	0.74
9	合计	70,619,030.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
5.2.1.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	50,477.70	0.07
B	采矿业	2,175,743.78	3.09
C	制造业	20,338,004.64	28.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,410,692.13	3.43
E	建筑业	2,050,230.30	2.92
F	批发和零售业	1,430,302.83	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,935,780.12	2.75
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,038,486.83	5.74
J	金融业	22,880,760.92	32.54
K	房地产业	3,312,397.01	4.71
L	租赁和商务服务业	707,823.74	1.01
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	443,864.30	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	111,379.97	0.16
R	文化、体育和娱乐业	921,351.46	1.31
S	综合	280,600.50	0.40
	合计	63,087,896.23	89.72

5.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	259,000.00	0.37
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,826,612.24	2.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	21,087.36	0.03
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	876,334.25	1.25
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	42,744.09	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	3,025,777.94	4.30

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通投资。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	306,735	2,739,143.55	3.90
2	601318	中国平安	81,246	2,603,121.84	3.70
3	600036	招商银行	121,551	2,127,142.50	3.03
4	000002	万 科A	69,765	1,269,723.00	1.81
5	600000	浦发银行	81,012	1,261,356.84	1.79
6	600519	贵州茅台	3,752	1,095,283.84	1.56
7	601328	交通银行	177,293	998,159.59	1.42
8	600030	中信证券	59,216	961,075.68	1.37
9	600837	海通证券	60,610	934,606.20	1.33
10	601288	农业银行	286,182	915,782.40	1.30

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300017	网宿科技	12,800	860,160.00	1.22
2	300450	先导智能	10,200	385,662.00	0.55
3	000955	欣龙控股	40,000	342,000.00	0.49
4	300193	佳士科技	27,200	282,608.00	0.40
5	002299	圣农发展	10,000	259,000.00	0.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细
股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和拟益明细
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.10.3 本期国债期货投资评价
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形
5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,510.58
2	应收证券清算款	506,081.03
3	应收股利	–
4	应收利息	1,618.50
5	应收申购款	4,582.75
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	524,792.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	1,269,723.00	1.81	停牌

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300450	先导智能	385,662.00	0.55	停牌
2	000955	欣龙控股	342,000.00	0.49	停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
报告期期初基金份额总额	67,173,680.67	340,158.39
报告期期间基金总申购份额	700,247.52	314,963.09
减：报告期期间基金总赎回份额	4,335,331.98	279,357.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	63,538,596.21	375,764.04

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
报告期期初管理人持有的本基金份额	–	122,023.00
报告期期间买入/申购总份额	–	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–	–
报告期末管理人持有的本基金份额	–	122,023.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	–	32.47

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内无申购、赎回或者买卖本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）相关批准文件
2.《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》
3.《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
4.《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》
5.基金管理人业务资格批件、营业执照
6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告
8.2 存放地点
基金管理人、基金托管人的办公场所。
8.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司；
客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一六年七月十九日

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期：2016年07月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧行业成长混合（LOF）	
场内简称	中欧成长	
基金主代码	166006	
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2015年01月30日	
报告期末基金份额总额	1,817,299,597.84份	
投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将通过分析宏观经济趋势、政府政策行为和资金供需关系三个影响资本市场的主要因素，在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，确定相应大类资产配置比例。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧行业成长混合（LOF）A	中欧行业成长混合（LOF）E
下属分级基金的场内简称	中欧成长	–
下属分级基金的交易代码	166006	001886
报告期末下属分级基金的份额总额	1,807,950,070.77份	9,349,527.07份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年04月01日-2016年06月30日）	
	中欧行业成长混合（LOF）A	中欧行业成长混合（LOF）E
1.本期已实现收益	52,824,253.98	257,286.46
2.本期利润	59,330,931.19	176,472.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0327	0.0264
4.期末基金资产净值	2,004,465,675.94	10,373,008.39
5.期末基金份额净值	1.1087	1.1095

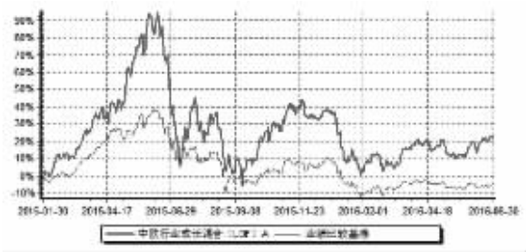
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中欧行业成长混合（LOF）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.70%	1.43%	-1.57%	0.76%	4.27%	0.67%

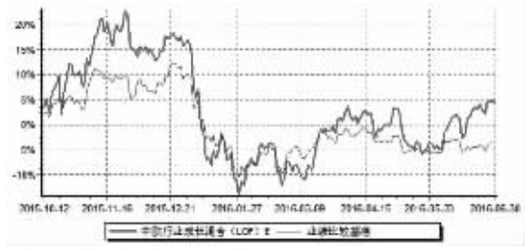
中欧行业成长混合（LOF）E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.70%	1.43%	-1.57%	0.76%	4.27%	0.67%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)A
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年1月30日-2016年06月30日）



注：本基金基金合同生效日期为2015年1月30日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。
中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)E
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2015年10月12日-2016年06月30日）



注：本基金于2015年10月8日新增E份额，图示日期为2015年10月12日至2016年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹剑飞	基金经理	2014年08月18日	2016年04月08日	13年	历任长江证券有限责任公司投资总部分析师、泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理、华宝兴业基金管理有限公司研究员、基金经理助理、农银汇理基金管理有限公司投资总监、农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金经理、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理、农银汇理低价值高增长股票型证券投资基金基金经理、农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014年4月加入中欧基金管理有限公司，历任投资总监、事业部负责人，中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。
李攻	基金经理	2016年01月08日		6年	历任国海富兰克林基金管理有限公司研究员，银河基金管理有限公司研究员。2015年12月加入中欧基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》及其各项实施细则，本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内，上证指数下跌2.47%，深证成指上涨0.33%，创业板指下跌0.47%。本季度市场风险偏好较前期有所回升，市场呈现出具有一定主线的震荡市特征。本基金在报告期内延续两类配置主线：一是具有稳定业绩增长的防御类资产，二是具备可持续度的高景气新兴行业。具体操作方面，本季度一直维持在中等仓位水平，并对持仓结构进行了调整，减持了部分价格走势已反映预期的个股，主要集中在农林牧渔、旅游、传媒等行业；增持了电子、以及家电、食品饮料、医药等稳定增长类资产。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内，基金A类份额净值增长率为2.70%，同期业绩比较基准收益率为-1.57%，基金E类份额净值增长率为2.70%，同期业绩比较基准收益率为-1.57%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,623,834,598.70	80.21
	其中：股票	1,623,834,598.70	80.21
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	378,125,384.64	18.68
8	其他资产	22,440,922.94	1.11
9	合计	2,024,400,906.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	51,074,389.64	2.53
B	采矿业	100,068,000.00	4.97
C	制造业	1,204,251,054.40	59.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	179,467,255.56	8.91
J	金融业	31,850,200.00	1.58
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	37,718,495.10	1.87
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,204.00	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	19,404,000.00	0.96
S	综合	–	–
	合计	1,623,834,598.70	80.59

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	564,000	164,642,880.00	8.17
2	000858	五 粮 液	4,617,100	150,194,263.00	7.45
3	300316	晶盛机电	10,099,823	132,307,681.30	6.57
4	300054	鼎龙股份	3,255,389	81,449,832.78	4.04
5	603818	曲美家居	4,799,985	76,799,760.00	3.81
6	300377	赢时胜	1,450,284	71,774,555.16	3.56
7	002456	欧菲光	2,217,616	65,419,672.00	3.25
8	600960	渤海活塞	5,999,950	60,239,498.00	2.99
9	600711	盛屯矿业	6,800,000	50,320,000.00	2.50
10	300363	博腾股份	1,999,932	49,638,312.24	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和拟益明细
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.10.3 本期国债期货投资评价
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,939,511.80
2	应收证券清算款	17,396,143.89
3	应收股利	–
4	应收利息	73,569.92
5	应收申购款	31,697.33
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	22,440,922.94

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧行业成长混合（LOF）A	中欧行业成长混合（LOF）E
报告期期初基金份额总额	1,655,474,886.21	6,574,857.30
报告期期间基金总申购份额	279,845,598.55	3,025,046.65
减：报告期期间基金总赎回份额	127,370,413.99	250,376.88
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	1,807,950,070.77	9,349,527.07

注：总申购份额含红利再投、转换入和强制调增份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	中欧行业成长混合（LOF）A	中欧行业成长混合（LOF）E
报告期期初管理人持有的本基金份额	–	128,619.02
报告期期间买入/申购总份额	–	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	–	128,619.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	–	1.38

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.《中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
2.《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF) 托管协议》
3.《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》
4.基金管理人业务资格批件、营